

# 博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金基金产品 资料概要更新

编制日期：2024年6月25日

送出日期：2024年6月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	博时恒生高股息 ETF	基金代码	513690
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国国际金融股份有限公司
基金合同生效日	2021-05-11	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2021-05-20
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	万琼	开始担任本基金基金经理的日期	2021-05-11
		证券从业日期	2007-03-01
场内简称	恒生股息		
扩位简称	恒生高股息 ETF		
其他概况	《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。		

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第十一章了解详细情况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。
投资范围	为更好地实现基金的投资目标，本基金可少量投资于依法发行上市的其他港股通标的股票等非成份股（含存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

#### 主要投资策略

基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%，预期年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括：债券（含可转换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、非成份股的股票投资策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、融资、融券及转融通证券出借策略、流通受限证券投资策略等。

#### 业绩比较基准

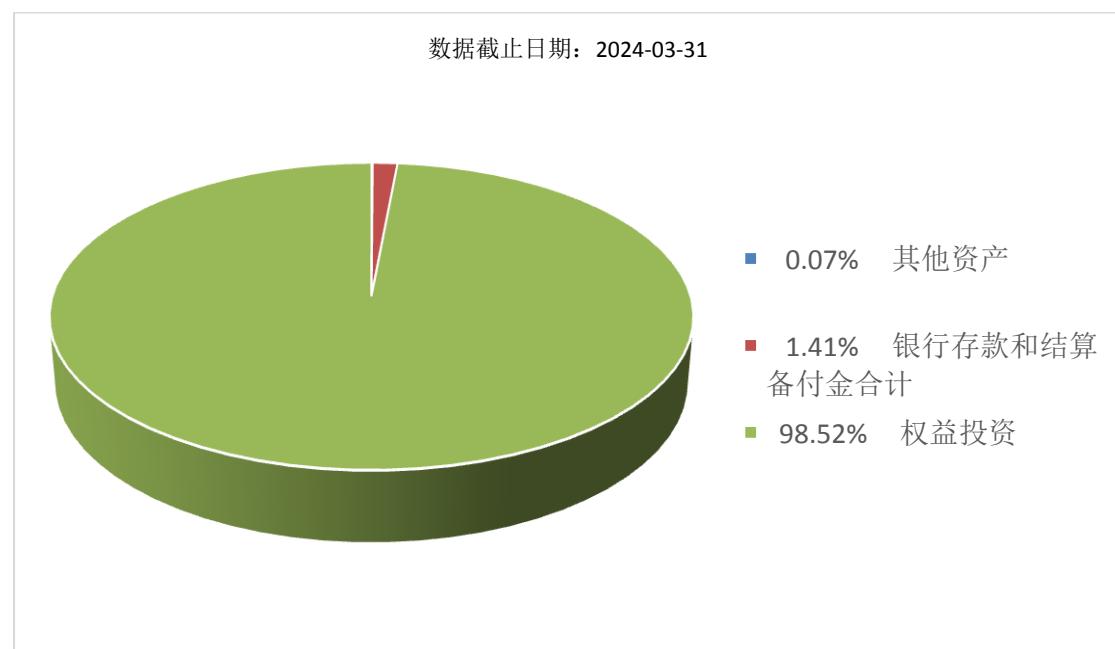
本基金的业绩比较基准为恒生港股通高股息率指数收益率（经估值汇率调整后）。

#### 风险收益特征

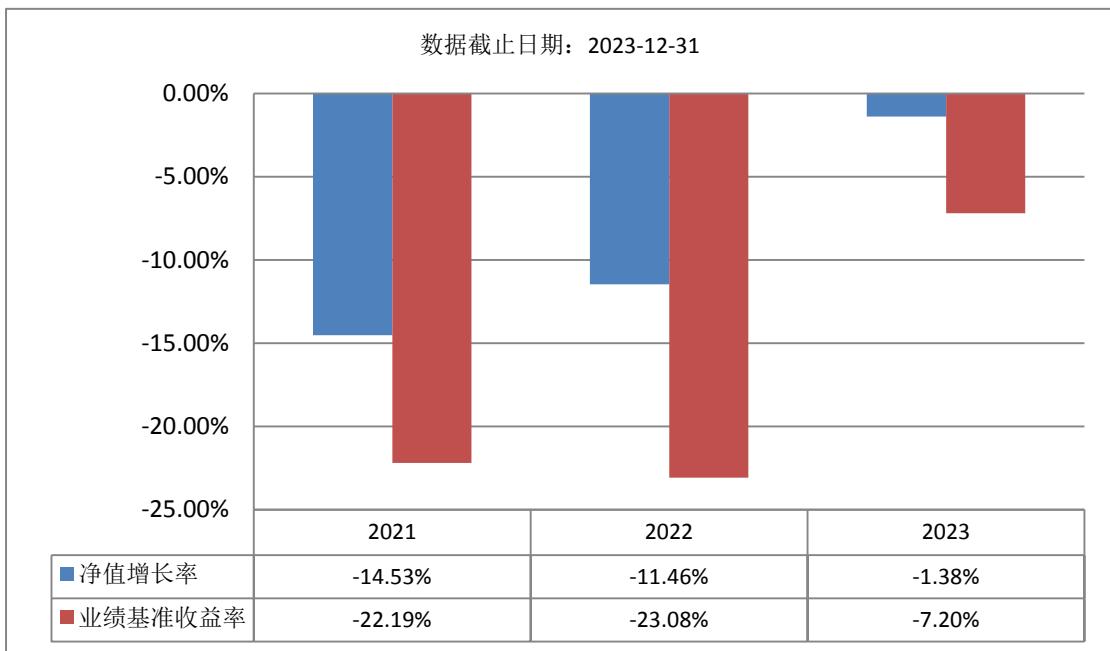
本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生港股通高股息率指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表



## （三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

场内交易费用以证券公司实际收费为准。

##### 申购费：

投资人在申购基金时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

##### 赎回费：

投资人在赎回基金时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	固定比例 0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	固定比例 0.10%	基金托管人
审计费用	62,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等，详见招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

#### (三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）

基金运作综合费率	0.66%
----------	-------

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

投资于本基金的主要风险包括：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资成本、费用以及指数成份股派发红利、指数成份股调整、成份股停牌、摘牌或流动性差、基金管理人管理能力等因素，可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率而产生的跟踪偏离风险。

4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。因此，投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

6、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.2%，预期年化跟踪误差不超过2%。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

7、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

(3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“基金份额的申购与赎回”之“申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

8、成份股退市的风险

标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

### 9、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

### 10、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险

基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据基金管理人提供的申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据及汇率数据计算并通过上海证券交易所发布的基金份额参考净值，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值与实时的基金份额净值可能存在差异，基金份额参考净值计算可能出现错误，投资人若参考基金份额参考净值进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

### 11、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

### 12、投资人申购失败的风险

本基金申购时，如果投资人未能提供符合要求的申购对价，申购申请可能失败。基金还可能在申购赎回清单中设定申购份额上限，如果投资人的申购申请接受后将使当日申购总份额超过申购份额上限，则投资人的申购申请可能失败。此外，如果申购赎回代理机构交收资金不足，登记机构将按照投资人申报时间先后顺序逐笔检查申购赎回代理机构的资金是否足额并相应确认申购份额，对于后申购的投资人，不论是否备足资金，都可能面临申购失败的风险。

### 13、投资人赎回失败的风险

投资人在提出场内份额赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致场内份额赎回失败的情形。

### 14、退补现金替代方式的风险

本基金在申购赎回环节的“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

### 15、基金场内份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括现金替代、现金差额等，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

### 16、投资风险

包括股指期货投资风险、国债期货投资风险、资产支持证券(ABS)投资风险、新股申购风险、股票期权风险、融资融券交易及转融通证券出借业务的主要风险、港股通机制下港股投资风险、存托凭证投资风险等。

### 17、自动清算的风险

基金存续期内，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。因此本基金有面临自动清算的风险。

### 18、其他风险

包括流动性风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)][客服电话：95105568]

(1) 基金合同、托管协议、招募说明书

- (2) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3) 基金份额净值
- (4) 基金销售机构及联系方式
- (5) 其他重要资料

## 六、其他情况说明

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，除裁决另有规定的，仲裁费用由败诉方承担。